

鹏扬现金通利货币市场基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬通利货币	
交易代码	004983	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 10 日	
报告期末基金份额总额	1,937,628,927.22 份	
投资目标	本基金在力求保持基金资产安全性与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金投资策略包括流动性管理策略、平均剩余期限和组合期限结构策略、资产配置策略、个券选择策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略等。在结合现金需求安排和货币市场利率预测，在保证基金资产安全性和流动性的基础上，获取稳定的收益。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于债券型基金、混合型基金与股票型基金。	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
下属分级基金的交易代码	004983	004984
报告期末下属分级基金的份额总额	53,189,813.49 份	1,884,439,113.73 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年1月1日—2020年3月31日）	
	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
1. 本期已实现收益	302,381.30	11,785,813.01
2. 本期利润	302,381.30	11,785,813.01
3. 期末基金资产净值	53,189,813.49	1,884,439,113.73

注：1、本期已实现收益指基金本期利息入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬通利货币 A

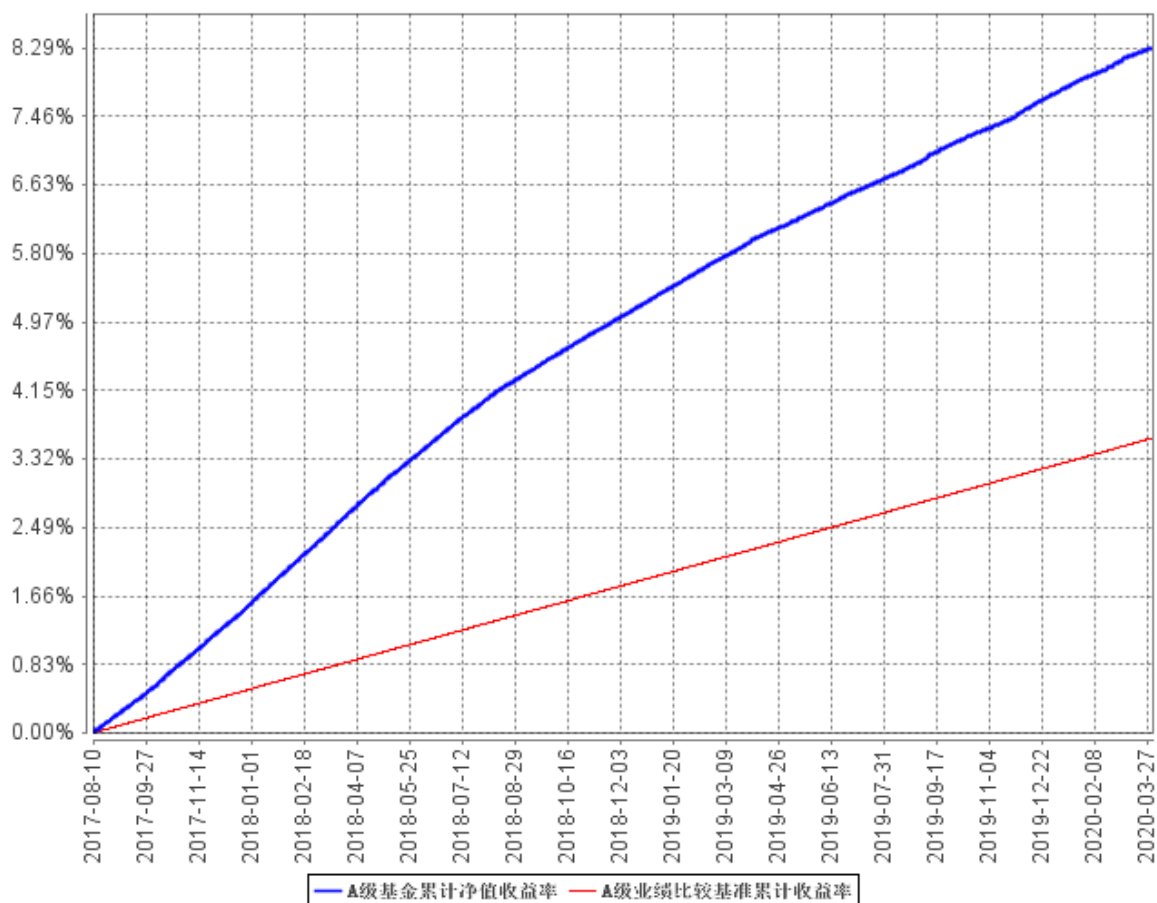
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5238%	0.0028%	0.3357%	0.0000%	0.1881%	0.0028%

鹏扬通利货币 B

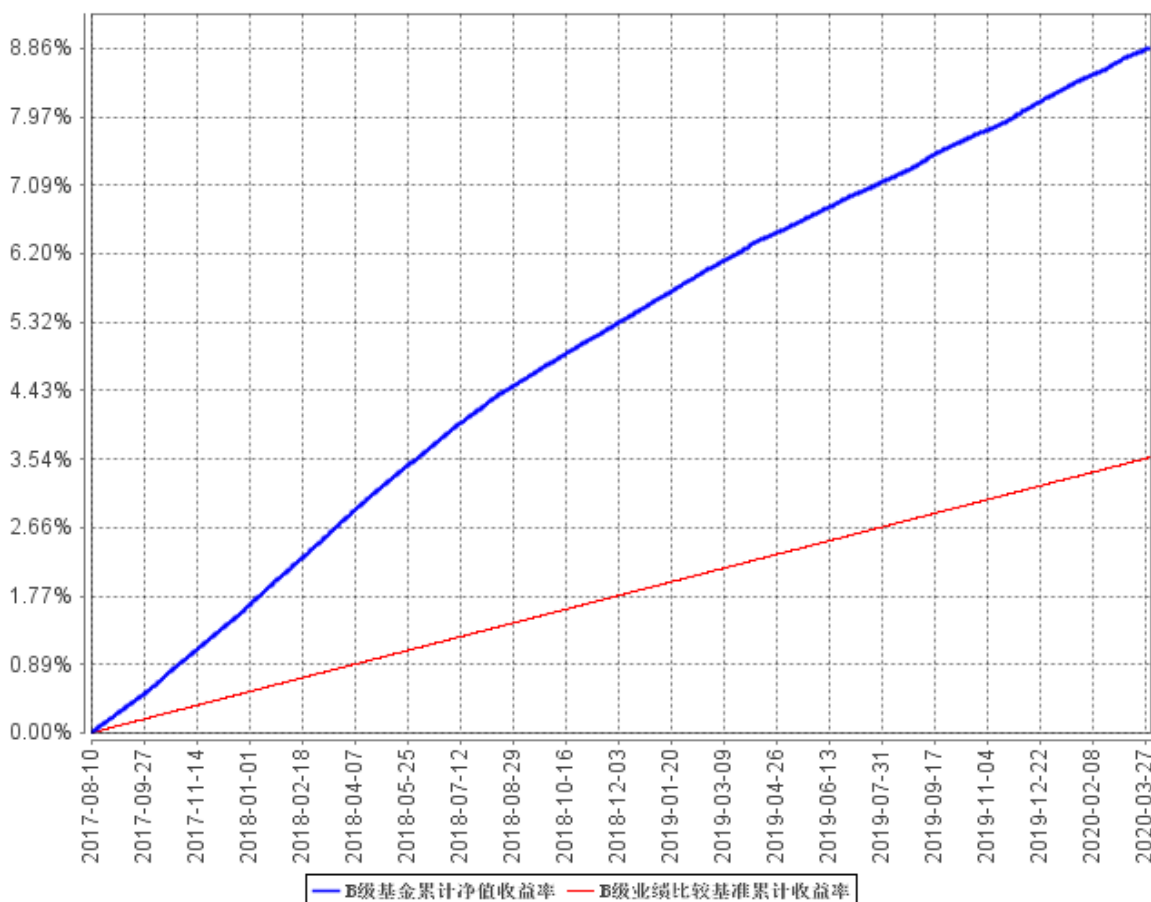
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5740%	0.0028%	0.3357%	0.0000%	0.2383%	0.0028%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2020 年 3 月 31 日。

（2）本基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。

（3）按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

（4）本报告期鹏扬通利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5238%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.5740%，同期业绩比较基准收益率为 0.3357%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钟闻	固定收益部执行总经理、现金策略总监，	2017年8月10日	2020年3月20日	7	北京理工大学工商管理硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司固定收益部投资经理、交易主管，负责银行投资顾问与

	本基金基金经理				利率债投资研究、债券交易工作。现任鹏扬基金管理有限公司固定收益部执行总经理、现金策略总监、固定收益投资决策委员会委员。2017 年 8 月 10 日至 2020 年 3 月 20 日任鹏扬现金通利货币市场基金基金经理，2018 年 1 月 19 日至今任鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 5 日至今任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 9 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理；2019 年 6 月 21 日至今任鹏扬淳盈 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2019 年 9 月 9 日至今任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 11 月 6 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 17 日至今任鹏扬浦利中短债债券型证券投资基金基金经理；
王莹莹	本基金基金经理	2018 年 8 月 24 日	-	4	北京交通大学经济学学士、英国埃克斯特大学硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。2016 年 8 月加入鹏扬基金管理有限公司，曾任交易管理部债券交易员、专户投资部投资组合经理。2018 年 8 月 24 日至今任鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬淳优一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、鹏扬现金通利货币市场基金基金经理，2019 年 11 月 13 日至今任鹏扬利沣短债债券型证券投资基金基金经理，2019 年 11 月 18 日至今任鹏扬淳开债券型证券投资基金基金经理，2020 年 3 月 16 日至今任鹏扬

					景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年受新冠病毒疫情冲击，全球经济逆转企稳复苏格局，呈现大幅回落并陷入技术性衰退格局。受 3 月以来海外疫情快速扩散影响，主要发达经济体的股票市场普遍出现 30%左右的大幅下跌，同时原油价格受需求下降和沙俄价格战供给冲击暴跌幅度超过 60%，全球金融市场陷入大幅波动之中，风险偏好下降到历史极低水平。全球主要央行货币政策重回大幅宽松，美联储大幅降息 150BP 重回零利率，并且重启量化宽松规模不设上限，欧央行、日本央行重启量化宽松。3 月 26 日，全球 G20 会议，20 国宣布推出 5 万亿美元的政策刺激计划，期待稳定全球经济和金融

市场。

2020 年一季度中国经济增长大概率为负增长。从 1-2 月数据上看，代表需求的固定资产投资和社会零售实际累计同比分别为 -24.5%和-23.7%，代表产出的 1-2 月工业增加值同比回落至 -13.5%。通货膨胀方面，受食品价格影响，2020 年 1-2 月我国 CPI 同比上涨 5.2%仍处于较高水平，但 3 个月环比折年率为 5.6%明显回落；非食品 CPI 同比上涨 0.9%，核心 CPI 同比上涨 1.0%，服务 CPI 同比上涨 0.6%，上述指标均较前值大幅回落，物价将逐步回落。2020 年 2 月我国工业生产者出厂价格指数（PPI）同比下降 0.4%，其中生产资料价格指数同比下降 1.0%。考虑到 3 月以来石油价格暴跌，工业品通货紧缩风险有所上升。流动性方面，央行连续降准并结合公开市场操作保持流动性合理充裕，政策利率方面，央行下调公开市场操作利率 30BP，并将超额存款准备金利率从 0.72%下降为 0.35%。

一季度债券市场大幅上涨，收益率曲线呈牛陡格局。3 年以内中短端品种受央行降准预期和宽松流动性支持，短端下行 60-70BP 左右，10 年以上长端下行幅度约 50-60BP。信用利差方面，除 1 年 AAA 品种受流动性支持，利差下降 10BP。受信用债券净供给大幅加大影响，AA+及以上的中高等级信用债券利差扩大约 15-20 BP 左右，AA 及以下的中低等级信用债券受经济下行压力和风险偏好下降，利差扩大 20-30BP。

债券策略方面，本基金在一季度始终保持在正偏离状态，全年日均正偏离 8bp，资产收益在 1 季度急剧下行，整体规模从年初 31 亿下降至季末 19 亿，在资产收益逐步下行前积极储备资产，并不断积累正偏离，积极调整组合资产结构，增加了信用债占比以维持一定程度的正偏离，增加了回购占比，以维持规模变化带来的流动性冲击，控制期限在 50 天以内，控制流动性风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期鹏扬通利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.5238%，本报告期鹏扬通利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.5740%，同期业绩比较基准收益率为 0.3357%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,239,486,491.56	63.93
	其中：债券	1,209,486,491.56	62.38
	资产支持证券	30,000,000.00	1.55
2	买入返售金融资产	679,376,899.07	35.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	539,740.42	0.03
4	其他资产	19,451,894.48	1.00
5	合计	1,938,855,025.53	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.29	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	52
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	50.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	15.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	3.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	10.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.58	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,544,425.04	6.22
	其中：政策性金融债	120,544,425.04	6.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	880,059,011.43	45.42
6	中期票据	30,374,294.71	1.57
7	同业存单	178,508,760.38	9.21

8	其他	-	-
9	合计	1,209,486,491.56	62.42
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	012000601	20 华能集 SCP002	1,800,000	179,791,226.68	9.28
2	012000323	20 苏交通 SCP002	1,500,000	149,955,745.79	7.74
3	011903050	19 南电 SCP024	1,000,000	100,114,107.23	5.17
4	011901635	19 华电 SCP023	1,000,000	100,016,176.04	5.16
5	112011064	20 平安银行 CD064	1,000,000	99,033,594.69	5.11
6	011903017	19 电网 SCP014	800,000	80,035,160.68	4.13
7	150208	15 国开 08	600,000	60,043,345.95	3.10
8	1702003	17 国开绿债 03	500,000	50,493,080.96	2.61
9	011903006	19 电网 SCP013	500,000	50,003,793.27	2.58
10	011903032	19 电网 SCP015	500,000	49,984,886.60	2.58

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1086%
报告期内偏离度的最低值	0.0528%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0781%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	165243	19 建花 11A	300,000.00	30,000,000.00	1.55

注：本基金本报告期末仅持有上述资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

20 平安银行 CD064 (112011064. IB) 为鹏扬现金通利货币市场基金的前十大持仓证券。2020 年 1 月 20 日中国银保监会深圳监管局针对平安银行存在以下主要违法违规事实，处以罚款 720 万元。主要违法违规事实如下：1. 汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；2. 代理保险销售的人员为非商业银行人员；3. 汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；4. 个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；5. 个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；6. 汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；7. 汽车消费及经营贷款审查不到位；8. 个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；9. 个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；10. 个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；11. 部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；12. 信用卡现金分期用途管控不力；13. 代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；14. 代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；15. “双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当。2019 年 7 月 2 日，平安银行和招商银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。

本基金投资 20 平安银行 CD064 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 平安银行 CD064 外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	10,014,178.77
3	应收利息	9,328,812.40

4	应收申购款	108,903.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,451,894.48

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬通利货币 A	鹏扬通利货币 B
报告期期初基金份额总额	71,746,946.55	3,004,543,888.67
报告期期间基金总申购份额	75,107,574.38	1,121,902,784.20
报告期期间基金总赎回份额	93,664,707.44	2,242,007,559.14
报告期期末基金份额总额	53,189,813.49	1,884,439,113.73

注：报告期期间基金总申购份额含转换入和分红份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	43-红利发放	2020年1月2日	1,315.24	0.00	0.00%
2	43-红利发放	2020年1月3日	659.97	0.00	0.00%
3	43-红利发放	2020年1月6日	1,940.72	0.00	0.00%
4	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
5	35-非交易过户出	2020年1月7日	16.36	0.00	0.00%
6	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
7	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
8	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
9	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
10	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
11	35-非交易过户出	2020年1月7日	18.00	0.00	0.00%
12	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
13	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
14	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
15	35-非交易过户出	2020年1月7日	7.96	0.00	0.00%
16	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
17	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%
18	35-非交易过户出	2020年1月7日	6.28	0.00	0.00%

19	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
20	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
21	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
22	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
23	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
24	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
25	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
26	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
27	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
28	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
29	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
30	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
31	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
32	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
33	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
34	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
35	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
36	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
37	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
38	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
39	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
40	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
41	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
42	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
43	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
44	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
45	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
46	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
47	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
48	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
49	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
50	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
51	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
52	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
53	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
54	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
55	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
56	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
57	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
58	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%

59	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
60	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
61	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
62	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
63	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
64	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
65	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
66	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
67	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
68	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	9.64	0.00	0.00%
69	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
70	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
71	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
72	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
73	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
74	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
75	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
76	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
77	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
78	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
79	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
80	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
81	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
82	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
83	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
84	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
85	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
86	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
87	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
88	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
89	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
90	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
91	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
92	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
93	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	11.32	0.00	0.00%
94	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
95	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
96	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
97	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
98	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%

99	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
100	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
101	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
102	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
103	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
104	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
105	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
106	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
107	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
108	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
109	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
110	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
111	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
112	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
113	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
114	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
115	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
116	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
117	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
118	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
119	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
120	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
121	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
122	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
123	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
124	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
125	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
126	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
127	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
128	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
129	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
130	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
131	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
132	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
133	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
134	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
135	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
136	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
137	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
138	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%

139	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
140	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
141	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
142	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
143	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
144	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
145	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
146	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
147	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
148	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
149	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
150	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
151	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
152	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
153	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
154	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
155	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
156	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
157	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
158	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
159	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
160	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
161	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
162	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
163	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
164	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
165	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
166	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
167	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
168	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
169	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
170	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
171	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
172	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
173	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
174	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
175	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
176	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
177	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
178	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%

179	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
180	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
181	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
182	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
183	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
184	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
185	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
186	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
187	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
188	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
189	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
190	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
191	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
192	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
193	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
194	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
195	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
196	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
197	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
198	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
199	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
200	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
201	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
202	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
203	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
204	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
205	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
206	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
207	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
208	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
209	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
210	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
211	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
212	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
213	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
214	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
215	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	7.96	0.00	0.00%
216	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
217	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	18.00	0.00	0.00%
218	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%

219	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
220	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
221	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	88.00	0.00	0.00%
222	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
223	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
224	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
225	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
226	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
227	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
228	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
229	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
230	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
231	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
232	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
233	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
234	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
235	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
236	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
237	35-非交易过户出	2020 年 1 月 7 日	6.28	0.00	0.00%
238	43-红利发放	2020 年 1 月 7 日	584.03	0.00	0.00%
239	43-红利发放	2020 年 1 月 8 日	556.44	0.00	0.00%
240	43-红利发放	2020 年 1 月 9 日	810.78	0.00	0.00%
241	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	7.96	0.00	0.00%
242	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
243	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
244	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	7.96	0.00	0.00%
245	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
246	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
247	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	9.64	0.00	0.00%
248	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
249	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
250	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
251	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
252	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
253	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
254	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
255	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
256	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	7.96	0.00	0.00%
257	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
258	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	7.96	0.00	0.00%

259	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
260	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
261	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
262	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
263	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
264	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
265	35-非交易过户出	2020 年 1 月 10 日	6.28	0.00	0.00%
266	43-红利发放	2020 年 1 月 10 日	1,412.33	0.00	0.00%
267	43-红利发放	2020 年 1 月 13 日	1,673.10	0.00	0.00%
268	43-红利发放	2020 年 1 月 14 日	567.33	0.00	0.00%
269	43-红利发放	2020 年 1 月 15 日	1,068.17	0.00	0.00%
270	43-红利发放	2020 年 1 月 16 日	603.53	0.00	0.00%
271	43-红利发放	2020 年 1 月 17 日	574.08	0.00	0.00%
272	43-红利发放	2020 年 1 月 20 日	2,472.15	0.00	0.00%
273	43-红利发放	2020 年 1 月 21 日	604.55	0.00	0.00%
274	43-红利发放	2020 年 1 月 22 日	1,026.07	0.00	0.00%
275	43-红利发放	2020 年 1 月 23 日	682.59	0.00	0.00%
276	43-红利发放	2020 年 2 月 3 日	6,689.87	0.00	0.00%
277	43-红利发放	2020 年 2 月 4 日	597.87	0.00	0.00%
278	43-红利发放	2020 年 2 月 5 日	557.49	0.00	0.00%
279	43-红利发放	2020 年 2 月 6 日	552.83	0.00	0.00%
280	43-红利发放	2020 年 2 月 7 日	628.39	0.00	0.00%
281	43-红利发放	2020 年 2 月 10 日	1,576.97	0.00	0.00%
282	43-红利发放	2020 年 2 月 11 日	527.48	0.00	0.00%
283	43-红利发放	2020 年 2 月 12 日	533.40	0.00	0.00%
284	43-红利发放	2020 年 2 月 13 日	539.41	0.00	0.00%
285	43-红利发放	2020 年 2 月 14 日	538.52	0.00	0.00%
286	43-红利发放	2020 年 2 月 17 日	1,647.84	0.00	0.00%
287	43-红利发放	2020 年 2 月 18 日	541.97	0.00	0.00%
288	43-红利发放	2020 年 2 月 19 日	540.07	0.00	0.00%
289	43-红利发放	2020 年 2 月 20 日	544.30	0.00	0.00%
290	43-红利发放	2020 年 2 月 21 日	1,705.84	0.00	0.00%
291	43-红利发放	2020 年 2 月 24 日	1,632.91	0.00	0.00%
292	43-红利发放	2020 年 2 月 25 日	535.38	0.00	0.00%
293	43-红利发放	2020 年 2 月 26 日	1,861.67	0.00	0.00%
294	43-红利发放	2020 年 2 月 27 日	539.46	0.00	0.00%
295	43-红利发放	2020 年 2 月 28 日	547.41	0.00	0.00%
296	43-红利发放	2020 年 3 月 2 日	1,632.63	0.00	0.00%
297	43-红利发放	2020 年 3 月 3 日	1,117.98	0.00	0.00%
298	43-红利发放	2020 年 3 月 4 日	551.55	0.00	0.00%

299	43-红利发放	2020 年 3 月 5 日	878.03	0.00	0.00%
300	43-红利发放	2020 年 3 月 6 日	1,853.24	0.00	0.00%
301	43-红利发放	2020 年 3 月 9 日	1,522.19	0.00	0.00%
302	43-红利发放	2020 年 3 月 10 日	613.28	0.00	0.00%
303	43-红利发放	2020 年 3 月 11 日	487.08	0.00	0.00%
304	43-红利发放	2020 年 3 月 12 日	506.85	0.00	0.00%
305	43-红利发放	2020 年 3 月 13 日	470.45	0.00	0.00%
306	43-红利发放	2020 年 3 月 16 日	1,390.27	0.00	0.00%
307	43-红利发放	2020 年 3 月 17 日	471.70	0.00	0.00%
308	43-红利发放	2020 年 3 月 18 日	458.83	0.00	0.00%
309	43-红利发放	2020 年 3 月 19 日	924.16	0.00	0.00%
310	43-红利发放	2020 年 3 月 20 日	439.63	0.00	0.00%
311	43-红利发放	2020 年 3 月 23 日	1,331.81	0.00	0.00%
312	43-红利发放	2020 年 3 月 24 日	429.38	0.00	0.00%
313	43-红利发放	2020 年 3 月 25 日	419.51	0.00	0.00%
314	43-红利发放	2020 年 3 月 26 日	1,208.04	0.00	0.00%
315	43-红利发放	2020 年 3 月 27 日	493.86	0.00	0.00%
316	43-红利发放	2020 年 3 月 30 日	1,115.32	0.00	0.00%
317	43-红利发放	2020 年 3 月 31 日	379.27	0.00	0.00%
合计			60,581.30	0.00	

注：本报告期内基金管理人非交易过户出、红利发放业务。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020 年 01 月 08 日 - 2020 年 03 月 31 日	516,646,246.97	2,977,839.67	0.00	519,624,086.64	26.82%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬现金通利货币市场基金募集的文件；
2. 《鹏扬现金通利货币市场基金基金合同》；
3. 《鹏扬现金通利货币市场基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2020 年 4 月 22 日